富国天博创新主题股票型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

基金管理人： 富国基金管理有限公司
基金托管人： 中国建设银行股份有限公司
报告送出日期： 2012年01月19日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年01月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年10月1日起至2011年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天博创新股票
基金主代码	519035
交易代码	前端交易代码：519035 后端交易代码：519036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年04月27日
报告期末基金份额总额（单位：份）	8,425,370,662.41
投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司，在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上，力争实现资本的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业组分、个券选择以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	中信标普300指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2011年10月01日-2011年12月31日）
1.本期已实现收益	-68,402,966.33
2.本期利润	-671,932,476.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0794
4.期末基金资产净值	6,235,480,231.41
5.期末基金份额净值	0.7401

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.72%	1.39%	-6.79%	1.13%	-2.93%	0.26%

注：过去三个月指2011年10月1日-2011年12月31日

3.2.2自基金转型以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：截止日期为2011年12月31日。

本基金于2007年4月27日由原汉博证券投资基金转型而成，建仓期6个月，从2007年4月27日至2007年10月26日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
毕天宇	本基金基金经理兼任权益投资副总监	2005-11-26	-	12年	硕士，曾任中国燕兴桂林公司汽车经营部经理助理；中国北方工业上海公司经理助理；兴业证券股份有限公司研究员；2002年3月任富国基金管理有限公司行业研究员，2005年11月至今任富国天博基金经理，兼任权益投资副总监。具有基金从业资格，中国国籍。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天博创新主题股票型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离、实行集中交易制度，严格执行交易系统中的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2在投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

组合	净值增长率	业绩比较基准收益率
[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]

-

4.3.3异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

四季度市场继续单边下跌，沪深300指数下跌9.13%，同期基金净值下跌9.72%。

四季度仓位变动不大，行业配置变化不大，主要对部分重仓个股持股比例进行调整。

展望2012年，我们认为市场最为纠结的房地产和通货膨胀两大因素都将逐步化解，宏观经济也将恢复常态。尽管一季度宏观数据和上市公司盈利将面临较大的压力，海外欧债危机也面临风险，但我们依旧看好中国经济的长期发展前景，抓住时机，积极准备，精选长期有投资价值的个股，坚定持有。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率为-9.72%，业绩比较基准收益率为-6.79%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,815,527,725.82	92.77
	其中：股票	5,815,527,725.82	92.77
2	固定收益投资	370,133,448.00	5.90
	其中：债券	370,133,448.00	5.90
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	22,471,109.09	0.36
6	其他资产	60,835,240.73	0.97
7	合计	6,268,967,523.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	358,608,440.44	5.75
C	制造业	2,578,917,128.24	41.36
C0	食品、饮料	537,555,000.00	8.62
C1	纺织、服装、皮毛	35,650,000.00	0.57
C2	木材、家具	4,460,000.00	0.07
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	102,770,221.69	1.65
C5	电子	4,264,336.45	0.07
C6	金属、非金属	267,213,485.85	4.29
C7	机械、设备、仪表	1,466,838,531.65	23.52
C8	医药、生物制品	160,165,552.60	2.57
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,053,532.44	0.79
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	651,778,578.04	10.45
H	批发和零售贸易	454,110,866.97	7.28
I	金融、保险业	1,054,140,526.69	16.91
J	房地产业	662,099,408.20	10.62
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	6,819,244.80	0.11
M	综合类	-	-
	合计	5,815,527,725.82	93.27

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000581	威孚高科	16,947,500	608,245,775.00	9.75
2	600519	贵州茅台	2,600,000	502,580,000.00	8.06
3	002024	苏宁电器	50,000,000	422,000,000.00	6.77
4	600031	三一重工	32,049,996	401,906,949.84	6.45
5	601166	兴业银行	30,000,000	375,600,000.00	6.02
6	600271	航天信息	18,150,897	360,476,814.42	5.78
7	000718	苏宁环球	60,000,000	314,400,000.00	5.04
8	600036	招商银行	21,000,000	249,270,000.00	4.00
9	000338	潍柴动力	6,049,963	190,573,834.50	3.06
10	000024	招商地产	10,011,118	180,200,124.00	2.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	166,880,448.00	2.68
2	央行票据	203,253,000.00	3.26
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	370,133,448.00	5.94

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1101016	11央票16	1,100,000	106,513,000.00	1.71
2	019120	11国债20	1,000,000	101,150,000.00	1.62
3	1101022	11央行票据22	1,000,000	96,740,000.00	1.55
4	010203	02国债(3)	656,320	65,730,448.00	1.05

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本期，本基金持有的苏宁环球于2011年12月27日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》，因公司涉嫌信息披露违规被立案调查。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余九名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.8.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,101,339.26
2	应收证券清算款	52,338,055.18
3	应收股利	-
4	应收利息	7,282,905.75
5	应收申购款	112,940.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,835,240.73

5.8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	8,509,707,721.86
报告期期间基金总申购份额	19,120,756.47
减：报告期期间基金总赎回份额	103,457,815.92
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	8,425,370,662.41

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立汉博证券投资基金的文件

2、汉博证券投资基金基金合同

3、汉博证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、中国证监会《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》

6、富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同

7、富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议

8、汉博证券投资基金财务报表及报表附注

9、富国天博创新主题股票型证券投资基金财务报表及报表附注

10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

7.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司
2012年01月19日

富国全球债券证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

基金管理人： 富国基金管理有限公司
基金托管人： 中国工商银行股份有限公司
报告送出日期： 2012年01月19日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年10月1日起至2011年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国全球债券（QDII-FOF）
基金主代码	100050
交易代码	前端交易代码：100050 后端交易代码：-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年10月20日
报告期末基金份额总额（单位：份）	167,487,783.29
投资目标	本基金主要投资于全球债券市场，通过运用基金中基金（FOF；fund of funds）这种国际流行的投资管理模式，力争实现资产运作细分化、组合配置最优化、风险管理精细化、风险调整后收益最大化，从而谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用战略资产配置与战术资产配置相结合的策略，通过“自上而下”的方式进行资产配置，在有效分散风险（如：分散投资于单一国家或区域债券基金、单一债券类型基金以及单一基金公司及经理人的投资风险）的同时，力争实现基金资产风险调整后收益最大化。在本基金资产组合的构建过程中，根据不同投资标的的投资等级和波动性等特征，基金资产被区分为核心资产和卫星资产。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：Barclay Global Aggregate Index。
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称： BMO Asset Management Inc. 中文名称： 蒙特利尔银行资产管理公司
境外资产托管人	英文名称： Brown Brothers Harriman & Co. 中文名称： 布朗兄弟哈里曼银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2011年10月01日-2011年12月31日）
1.本期已实现收益	-7,691,303.04
2.本期利润	2,012,693.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0114
4.期末基金资产净值	160,361,925.98
5.期末基金份额净值	0.957

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

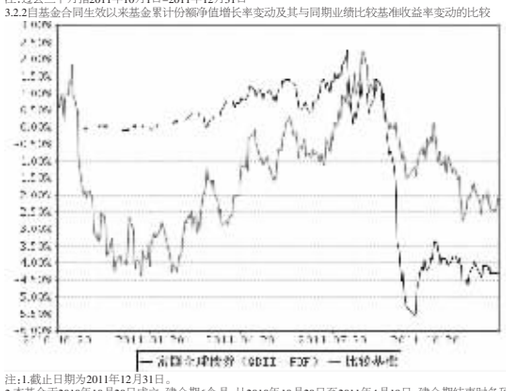
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.06%	0.19%	-0.62%	0.31%	1.68%	-0.12%

注：过去三个月指2011年10月1日-2011年12月31日

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.截止日期为2011年12月31日。

2.本基金于2010年10月20日成立，建仓期6个月，从2010年10月20日至2011年4月19日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张峰	本基金基金经理兼任富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理	2011-04-12	-	10年	硕士，曾任摩根史丹利研究部助理，里昂证券投票分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自2009年7月至2011年4月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人，自2011年4月起任富国全球债券证券投资基金基金经理，自2011年7月起任富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国香港。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Michael Stanley	投资长、总裁、执行长	18	执行长，同时也担任投资长，并负责管理加拿大股票组合，1994年加入蒙特利尔银行，然后在1996年2月加入蒙特利尔资产管理公司至今。1979年获得多伦多大学管理硕士，同时是注册金融分析师
Mark McMahon	资深副总裁及固定收益主管	23	在加拿大固定收益市场有超过22年经验，从2004年末开始成为蒙特利尔资产管理公司固定收益的领导投资经理至今，在此前，曾负责管理蒙特利尔资产管理公司客户的债券组合，1999年到加入蒙特利尔银行前，在一家主要券商负责管理零售交易并且是私人客户部门的固定收益投资策略师，1987年毕业于西蒙菲沙大学，主修经济与金融，同时也是注册金融分析师

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国全球债券证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国全球债券证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统中的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.4.2本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

4.4.3异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

接近三季度末，国际资本市场由于担心希腊在四季度无序破产，恐慌情绪加剧。美国国债作为避险的工具受到资金追捧，10年期国债收益率一度跌至1.7%的历史新低，即使在2008年的金融危机中，该收益率最低值也在2%以上。同时带有一定风险属性的债券资产，包括新兴市场债券与高收益债券，遭到抛售，价格大幅下挫。进入四季度，美国方面陆续公布各类经济数据，从房地产价格、开工、交易，PMI，新增就业，失业率到第三季度GDP，都好于市场预期，显示美国经济继续逐渐复苏，打消了二次探底的担忧。欧洲方面，虽然债务危机尚没有得到解决，但取得了一些进展。最值得指出的是欧洲央行通过长期再融资（Long Term Refinancing Operation）操作向银行注入大量流动性，降低了银行的资金周转压力，一定程度上降低了主权债务问题的恶化速度，为采取进一步措施赢得了时间。基于以上两点原因，债券市场的各类资产价格逐渐趋于理性。本基金的四季度超额收益主要来自适当低配了避险资产，保留了现金、部分新兴市场和高收益债券头寸。

人民币期间升值0.85%，对基金净值造成负面冲击。展望未来，我们倾向于认为人民币升值的幅度与速度都会降低，因此基金净值收到此方面的冲击有可能减小。2012年一季度是欧洲主权债务的再融资需求较大，会对资本市场带来压力，到目前为止，欧洲尚未出台有效的危机解决方案。本基金将采取较为谨慎的投资策略，持有较高比例的避险类资产，有望帮助投资人比较好的规避来自欧洲的系统性风险。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

本报告期，基金净值增长率为1.06%，业绩比较基准收益率为-0.62%。

§5 投资组合报告

5.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	129,638,313.47	72.13
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	39,300.00	0.02
	其中：远期	39,300.00	0.02
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	16,000,000.00	8.90
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	33,930,809.10	18.88
8	其他资产	111,559.47	0.06
9	合计	179,719,982.04	100.00

5.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

5.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

5.5 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	PIMCO-GLOBAL BOND-US UH I AC	开放式	普通开放式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	26,879,878.14	16.76
2	SKANDIA-GLOBAL BOND-A	开放式	普通开放式基金	Wellington Management Co LLP	24,847,619.69	15.49
3	ISHARES IBOXX INV GR CORP BD	开放式	ETF基金	BlackRock Fund Advisors	22,292,180.94	13.90
4	ISHARES BARCLAYS 1-3 YEAR TR	开放式	ETF基金	BlackRock Fund Advisors	15,972,781.50	9.96
5	ISHARES BARCLAYS AGGREGATE	开放式	ETF基金	BlackRock Fund Advisors	10,281,178.53	6.41
6	LM-WA ASIAN OPPS. FD-AA¥	开放式	普通开放式基金	Legg Mason Investments Europe Ltd	5,057,107.32	3.15
7	FIDELITY FNDS-US HIGH YLD-A¥	开放式	普通开放式基金	FIL Fund Management Ltd	4,717,020.71	2.94
8	FULLERTON ASIAN BOND-A	开放式	普通开放式基金	Fullerton Fund Management Co Ltd	4,196,293.48	2.62
9	FIDELITY-ASIAN HI YLD-A¥	开放式	普通开放式基金	FIL Fund Management Ltd	3,488,171.56	2.18
10	PIMCO GIS-EURO CREDIT-INS AC	开放式	普通开放式基金	Pimco Global Advisors Ltd	3,324,829.82	2.07

5.10 投资组合报告附注

5.10.1申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的基金。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	99,397.45
4	应收利息	7,147.89
5	应收申购款	5,014.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,559.47

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	193,037,055.74
报告期期间基金总申购份额	412,698.81
减：报告期期间基金总赎回份额	25,961,971.26
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	167,487,783.29

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国全球债券证券投资基金的文件

2、富国全球债券证券投资基金基金合同

3、富国全球债券证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国全球债券证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

7.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司
2012年01月19日

富国全球顶级消费品股票型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

基金管理人： 富国基金管理有限公司
基金托管人： 中国工商银行股份有限公司
报告送出日期： 2012年01月19日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年10月1日起至2011年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国全球顶级消费品股票（QDII）
基金主代码	100055
交易代码	前端交易代码：100055 后端交易代码：-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年07月13日
报告期末基金份额总额（单位：份）	274,378,516.42
投资目标	本基金主要投资于全球顶级消费品相关公司的股票，通过对投资对象的精选和组合投资，分散投资风险，力求实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”资产配置与“自下而上”个券精选相结合的主动投资管理策略，通过精细化的风险管理，力求实现基金资产的中长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金的业绩基准为道琼斯奢侈品指数（Dow Jones Luxury Index）。
风险收益特征	本基金为主要投资于全球顶级消费品制造商和顶级消费服务提供商的主动股票型基金，属于证券投资基金中高风险高预期收益的品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称： BMO Asset Management Inc. 中文名称： 蒙特利尔银行资产管理公司
境外资产托管人	英文名称： Brown Brothers Harriman & Co. 中文名称： 布朗兄弟哈里曼银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2011年10月01日-2011年12月31日）
1.本期已实现收益	-9,703,603.48
2.本期利润	-2,140,802.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0075
4.期末基金资产净值	255,797,273.32
5.期末基金份额净值	0.932

注：本基金合同于2011年7月13日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

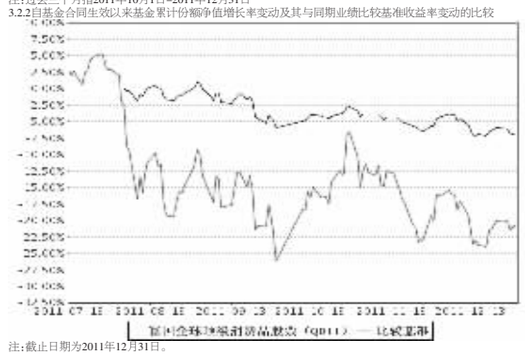
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.96%	0.46%	7.37%	2.60%	-8.33%	-2.14%

注：过去三个月指2011年10月1日-2011年12月31日

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：截止日期为2011年12月31日。

本基金合同生效日为2011年7月13日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金建仓期6个月，即从2011年7月13日起至2012年1月12日，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张峰	本基金基金经理兼任富国全球债券证券投资基金基金经理	2011-07-13	-	10年	硕士，曾任摩根史丹利研究部助理，里昂证券投票分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自2009年7月至2011年4月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人，自2011年4月起任富国全球债券证券投资基金基金经理，自2011年7月起任富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国香港。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Michael Stanley	投资长、总裁、执行长	18	执行长，同时也担任投资长，并负责管理加拿大股票组合，1994年加入蒙特利尔银行，然后在1996年2月加入蒙特利尔资产管理公司至今。1979年获得多伦多大学管理硕士，同时是注册金融分析师
Mark McMahon	资深副总裁及固定收益主管	23	在加拿大固定收益市场有超过22年经验，从2004年末开始成为蒙特利尔资产管理公司固定收益的领导投资经理至今，在此前，曾负责管理蒙特利尔资产管理公司客户的债券组合，1999年到加入蒙特利尔银行前，在一家主要券商负责管理零售交易并且是私人客户部门的固定收益投资策略师，1987年毕业于西蒙菲沙大学，主修经济与金融，同时也是注册金融分析师

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国全球顶级消费品股票型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以为投资者减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统中的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.4.2本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

4.4.3异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基